

<<資金需給>>

単位 億円

	30日需給速報		31日需給予想	1日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 200	▲ 700	0
財政		500	▲ 600	▲ 5,000
資金過不足		300	▲ 1,300	▲ 5,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				12,900
104,598				▲ 10,400
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				
国庫短期証売却				
国債買入		9,100		6,300
CP等買入		3,900		
		▲ 100	▲ 4,300	
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488				
被災地支援				
3,623				
社債等買入		▲ 100		
ETF買入				
国債補完供給				
小計		12,800	▲ 4,300	8,800
当預増減		13,100	▲ 5,600	3,800

当座預金残高	1,526,800	7/30以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,389,700		39,800
積み終了先	1,170,400	7/31以降の残り所要積立額	
超過準備	1,170,400	積数	35,500
非準預先残高	137,100	1日平均	2,200
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)			1,907,100
準備預金進捗率	98.14%	(実績)	48.39% (日数)

7/29のマナタリーベース				2,424,200
7/29コール	合計	174,441	無担	76,066
			有担	98,375
コール前日増減	計	377	無担	▲ 2,009
			有担	2,386

7/30の加重平均レート(速報)				7/29の加重平均レート(確報)			
無担(平均)	有担(平均)	CP配a-1	短国	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.050 ~0.135 (0.065)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.050 ~0.135 (0.066)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.064 ~0.120 (0.070)					0.065 ~0.130 (0.105)		
0.117 ~0.130 (0.120)					0.071 ~0.200 (0.124)		
0.330 (0.330)					0.170 ~0.330 (0.197)		
0.115 (0.115)							
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-	1M	0.090 (0.090)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M	0.117 (0.117)		
		0.08-0.12	-	3M			
		-	0.0140	6M			
		-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	15,000億円	8/1 ~ 11/11 (102日間)	応札	12,880億円	落札	12,880億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債買入	3,000億円	8/1	応札	11,673億円	落札	3,000億円	全取利回り較差	0.006%	平均利回り較差	0.006%	
国債買入	2,000億円	8/1	応札	8,746億円	落札	2,004億円	按分利回り較差	0.001%	平均利回り較差	0.001%	
国債買入	1,000億円	8/1	応札	4,421億円	落札	1,003億円	按分利回り較差	-0.004%	平均利回り較差	-0.003%	
国債買入	300億円	8/1	応札	1,892億円	落札	300億円	按分利回り較差	-0.013%	平均利回り較差	-0.012%	
交付税特会	1兆500億円	8/7~2015/2/4	応札	2兆8,695億円	落札	1兆500億400万円	0.100%	按分	35.8060%	平均	0.099%

7/31の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,521,200	前日比	▲ 5,600
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.06~0.065%近辺での出合いが中心となるであろう。

<< 30日のインターバンク市場動向 >>
 午前8時発表の準備預金残高見込みは、117兆8,000億円(当座預金残高見込みは152兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.063%前後、大手行からは0.06%付近での調達希望で始まり、出合いの中心は0.063%となった。一巡後は、調達レートが低下し、0.06%近辺での出合いが散見される程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、本日も目立った出合いはなく、ロール案件での取引が散見される程度であった。

<< 30日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは0.06~0.07%程度となり、前日比で上昇した。短国アウトライト市場は6M:0.014%の出合いが見られた。明日の3M入札を控えて様子見姿勢が強く、レート気配は前日から横ばい圏となっていた。CP市場は一部で月末発行案件が見られ、発行総額2,500億円程度となった。前日の月末発行分も影響してやや荷もたれ感があり、発行レートは横ばいからやや上昇気味との印象であった。

<< 31日の材料 >>
 *6月の毎月勤労統計調査速報
 *6月の住宅着工統計
 *木内日銀審議委員、兵庫県金融経済懇談会にて講演
 *ユーロ圏7月の消費者物価指数速報値
 *米国7月のシカゴP.M景況感指数
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、8/4発行)

JGB新発10年債	0.525	0.000	日経平均株価(終値)	15,646.23	28.16	為替(9時)	102.08-09
						為替(5時)	102.16-17

O/N加重平均レートと日銀当座預金残高及び準備預金残高の推移						
日付	7/23	7/24	7/25	7/28	7/29	7/30
日銀当預残	1,510,800	1,511,400	1,499,000	1,485,600	1,513,700	1,526,800
準備預金残	1,383,900	1,381,200	1,374,400	1,360,600	1,386,900	1,389,700
レート	0.067%	0.067%	0.070%	0.066%	0.066%	0.065%
月中平均	0.06587%	0.06592%	0.06637%	0.06636%	0.06634%	0.06630%

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。」

金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目論見書をよくお読みください。
 セントラル短資株式会社 登録金融機関 関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入